

SMARTRC

Mayo, 2024

Actinver

Asset Management

ETF Multifactor



El SMARTRC replica al índice S&P/BMV Bursa Óptimo que busca la creación de un portafolio eficiente que maximice el rendimiento mediante procesos de optimización. Incluye cinco variables fundamentales y dos operativas maximizando el *Sharpe Ratio del portafolio*.

¿POR QUÉ INVERTIR EN EL FONDO?



1. Acceso a una alternativa de mediano y largo plazo que, en base a su historia, tiene mayores rendimientos que el S&P/BMV IPC.
2. Acceso a una portafolio con estrategia multifactorial y diversificado.
3. Fácil de comprar y vender en el mercado.

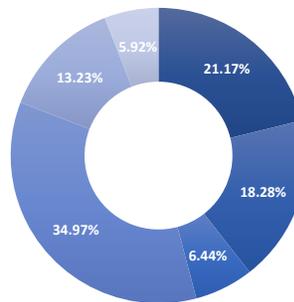
INFORMACIÓN CLAVE

Clave de Pizarra	SMARTRC 14
Gastos Totales	0.65%
Índice referencia	S&P/BMV Bursa Óptimo
Ticker Bloomberg	VDMEX Index
Horizonte	Mediano/Largo Plazo
Inversionista	Física, Moral
Compras/Ventas	Todos los días hábiles
Liquidación	24 hrs.
Activo Neto (mdp)	\$3 MM

CARTERA: 10 POSICIONES PRINCIPALES¹

Identificador	ISIN	Sector	Peso
GMEXICO B	MXP370841019	Materiales	6.83%
BIMBO A	MXP495211262	Cons. Básico	6.34%
GRUMA B	MXP4948K1056	Cons. Básico	6.01%
GAP B	MX01GA000004	Industrial	5.70%
ASUR B	MXP001661018	Industrial	5.65%
GFNORTE O	MXP370711014	Financiero	5.40%
CEMEX CPO	MXP225611567	Materiales	5.06%
AC *	MX01AC100006	Cons. Básico	4.83%
FEMSA UBD	MXP320321310	Cons. Básico	4.81%
WALMEX *	MX01WA000038	Cons. Básico	4.75%
Total			55.38%

CARTERA POR SECTOR¹

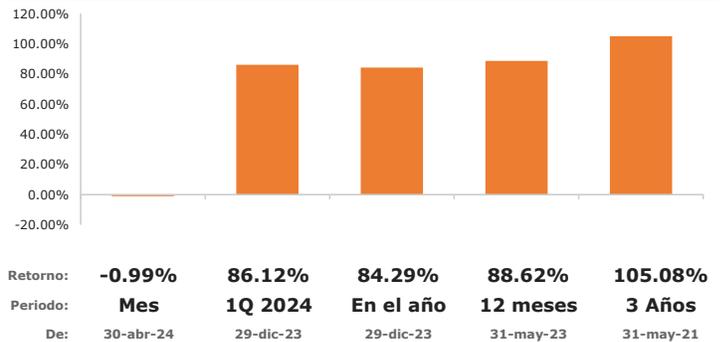


Sector	Peso
Energía	0.00%
Materiales	21.17%
Industrial	18.28%
Cons. Discr.	6.44%
Cons. Básico	34.97%
Salud	0.00%
Financiero	13.23%
Tecnología	0.00%
Comunicaciones	5.92%
Servicios	0.00%
Bienes Raíces	0.00%
Total	100.00%

EVOLUCIÓN DE UNA INVERSIÓN DE \$1,000.00 MXN²



DESEMPEÑO DEL FONDO AL 31/MAY/2024



RENDIMIENTOS MENSUALES

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	AÑO
2024	-0.41%	81.07%	3.21%	0.01%	-0.99%								84.29%
2023	12.50%	-4.10%	3.19%	1.70%	-4.23%	-1.62%	1.93%	-2.06%	-4.36%	-6.13%	9.03%	6.45%	10.97%
2022	-1.39%	4.12%	3.33%	-6.95%	0.73%	-8.12%	3.21%	-6.48%	-1.49%	11.60%	4.68%	-4.94%	-3.53%
2021	-3.48%	3.24%	5.59%	2.19%	4.66%	-0.15%	0.31%	3.36%	-3.10%	1.34%	-2.49%	4.86%	16.97%

Actinver

Asset Management

Para mayor información, comuníquese con Jaime Merino
jmerino@actinver.com.mx

Centro de Atención Telefónica (CAT) 55-1103-6699

Donde contratar:

- Banca electrónica (e-Actinver)
- Plataforma inversiones (Bursanet)
- Casa Bolsa / Banco Actinver

Recomendaciones antes de contratar:

- Conocer el índice.
- Conocer las características del ETF.

1. Composición de cartera con información de mercado al cierre del 31/May/2024.
2. Representa el rendimiento acumulado de \$1,000 MXN calculado con precios teóricos al cierre del 31/May/2024.

El precio teórico puede diferir del precio de mercado.
El desempeño en el pasado puede no ser indicativo del desempeño que tendrá en el futuro. Los resultados pueden ser positivos o negativos.
Fuente: Actinver Asset Management